

季節調整値の訂正等について

平成 23 年 3 月 22 日
内閣府経済社会総合研究所
景気統計部

景気動向指数の採用系列である C3 大口電力使用量については、内閣府で独自に季節調整を行っています。ホリデーファイル（休日日数を計算したもの）の作成方法は、1 月分速報（冊子）の「11 利用の手引き 4.その他 X-12-ARIMA のスペックファイルの設定方法 b RegARIMA」17 頁に記した通り、「各年各月の休日日数から利用する期間の平均休日日数を差し引いた系列」としておりましたが、1 月分速報時に公表した系列は、平均休日日数を差し引かない「各年各月の休日日数」を用いて季節調整を行っておりました。

この原因としては、1 月よりシステムを移行した際に、休日日数ファイルはそのまま用いたものの、季節調整替えを行う過程で、平均日数を計算にして控除するプログラム（作業過程）が抜け落ちていたためです。

1 月分改訂では、上記の誤りを訂正するとともに、平成 4(1992)年 5 月より全ての土曜日が休日となった影響も補正するため、休日日数の調整を「各月の休日日数から、利用する期間の平均休日日数（平成 4 年 4 月までとそれ以降の期間とに分ける）」と変更し、季節調整値を再計算し、また、利用の手引きを修正しました。（表 1 (P1)を参照。）

政府統計の総合窓口（e-stat）上は、正誤情報へのリンク設定をしました。

上記の問題が及ぼした影響については、「平均日数を差し引かない休日日数」を用いると、その分だけ季節調整済系列の水準値が原数値より押し上げられることとなります。ただし、景気動向指数の一致 CI を作成する際に使用している前月比には、影響がほとんど現れません（表 2 (P2) 参照）。その結果、1 月分改訂と 1 月分速報ではほぼ同値となり、一致 CI への影響は軽微でした。

利用者の皆様にはご迷惑をお掛けしたことをお詫び申し上げますと共に、ご指摘いただいた方々には御礼を申し上げます。

表 1 1 月速報（冊子）についての正誤表

該当箇所	誤	正
平成23年1月分速報 公表冊子 11.景気動向指数の利用の手引き 4.その他 X-12-ARIMAのスペックファイルの設定方法 b.RegARIMAモデルの選定方法等 9行目	なお、曜日調整には、X-12-ARIMAに用意されている標準的な曜日調整コマンドの他、日本の祝祭日、土曜日休みの普及及び慣行として休日扱いとなっている日（年末年始休み、ゴールデンウィーク中の2日以内のウィークデイ、お盆休み）を含めたホリデーファイル（各月の休日日数から利用する期間の平均休日日数を差し引いた系列）を作成し用いる。	なお、曜日調整には、X-12-ARIMAに用意されている標準的な曜日調整コマンドの他、日本の祝祭日、土曜日休みの普及及び慣行として休日扱いとなっている日（年末年始休み、ゴールデンウィーク中の2日以内のウィークデイ、お盆休み）を含めたホリデーファイル（各月の休日日数から、利用する期間の平均休日日数（平成4年4月までとそれ以降の期間とに分ける）を差し引いた系列）を作成し用いる。

